

## RBSPREV PLANO CV

A Entidade acompanhará os indicadores definidos na política de investimentos para evidenciação da capacidade de pagamento de suas obrigações com os participantes. Tais indicadores foram baseados nos índices de liquidez desenvolvidos pela PREVIC e publicados no Relatório de Estabilidade da Previdência Complementar, com adaptação de metodologia para adequação das informações disponíveis.

Não serão estabelecidos parâmetros mínimos, sem prejuízo de vir a agir quando os níveis dos índices a seguir apresentados estiverem abaixo de 1.

---

### Parâmetros

---

Data-base dos Ativos: **31/12/2020**  
Data de Avaliação do Passivo: **31/12/2019**

---

### ILG - Índice de Liquidez Global

---

O índice de liquidez global (ILG) tem por objetivo mensurar a disponibilidade de ativos líquidos, independentemente dos respectivos prazos de vencimento ou da volatilidade, para fazer frente às obrigações com participantes projetadas para cinco anos.

Ativos de Liquidez nível 1: 205.570.494,05  
Ações Nível 1: 24.778.484,14  
VP Passivo - Próximos 5 anos: -2.392.071,50

**ILG 96,30**

Quando superior a um, o índice informa a existência de fluxos de ativos com liquidez em montante superior aos passivos atuariais líquidos, indicando que não há insuficiência de ativos para cobrir as obrigações.

---

### ILCP - Índice de Liquidez de Curto Prazo

---

O índice de liquidez de curto prazo (ILCP) relaciona o valor presente (VP) dos títulos de renda fixa em carteira (títulos públicos, títulos privados e operações compromissadas) de prazos de vencimentos curtos (até cinco anos) com os VP das obrigações atuariais líquidas das contribuições, no mesmo prazo (até cinco anos).

Inflação: 105.220.957,30  
Pré: 9.596.614,82  
Outros: 66.819.976,19  
Valor Total RF: 181.637.548,31  
VP Passivo - Próximos 5 anos: -2.392.071,50

**ILCP 75,93**

Quando superior a um, o índice informa a existência de fluxos de renda fixa em montante superior aos passivos atuariais líquidos, indicando menor necessidade de realizar outros ativos para cobrir as obrigações no período de referência. Portanto, o ILCP maior tende a reduzir a exposição ao risco de mercado.

